

## เอกสารอ้างอิง

- กรรณิการ์ ไชยลังกา. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ธนาคารพาณิชย์ขนาดกลางในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีการโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- กัทธิยา พานประเสริฐ. 2550. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนหลักทรัพย์กลุ่มธนาคารพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยใช้แบบจำลอง ฟามาและเฟรนช์. การค้นคว้าแบบอิสระเศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ชัยโย กรกิจสุวรรณ. 2540. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในกลุ่มพลังงานในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. 2553. ข้อมูลบริษัทหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. แหล่งที่มา: <http://www.set.or.th>. (3 มกราคม 2553)
- ทรงศักดิ์ ศรีบุญจิตต์. 2545. เศรษฐมิตติ: เอกสารประกอบการสอน. เชียงใหม่: คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- ธนาคารแห่งประเทศไทย. 2552. ข้อมูลอัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ 3 เดือน. แหล่งที่มา: <http://www.bot.co.th>. (16 พฤศจิกายน 2552)
- บริษัทเซทเทรดคอตคอม จำกัด. 2552. ข้อมูลการซื้อขายหลักทรัพย์. แหล่งที่มา: <http://www.setsmart.com>. (20 ธันวาคม 2552)
- พิเชษฐ พรหมสุข. 2540. การวิเคราะห์ปัจจัยที่มีอิทธิพลต่อค่าพรีเมียมและค่าชดเชยความเสี่ยงในการซื้อขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- เยาวลักษณ์ อรุณมีศรี. 2534. การลงทุนในหลักทรัพย์ของชาวต่างประเทศในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย. วิทยานิพนธ์เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.
- รังสรรค์ หทัยเสรี “Cointegration and Error Correction Approach : ทางเลือกใหม่ในการประยุกต์ใช้กับแบบจำลองทางเศรษฐกิจมหภาคของประเทศไทย.” วารสารเศรษฐศาสตร์ธรรมศาสตร์, 13 (กันยายน 2538) :20-55.

รุ่งระวี สิทธิกร. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์ขนส่งในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีการโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

ศิริกาญจน์ สุวรรณะ 2550. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มพาณิชย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีการโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

สุนทรา สุกันธา. 2546. การวิเคราะห์ความเสี่ยงของหลักทรัพย์ธุรกิจเกษตรในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยวิธีการโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

อนก อุปรา. 2547. การวิเคราะห์ความเสี่ยงและผลตอบแทนของหลักทรัพย์กลุ่มบันเทิงและสันทนาการโดยวิธีโคอินทิเกรชัน. การค้นคว้าแบบอิสระ เศรษฐศาสตรมหาบัณฑิต มหาวิทยาลัยเชียงใหม่.

Dale O. Cloninger & Edward R. Waller & Yvette Bendeck & Lee Revere, 2004. "Returns on negative beta securities: implications for the empirical SML," Applied Financial Economics, Taylor and Francis Journals, vol. 14(6), pages 397-402, March.

Enders, W. **Applied Econometric Time Series**. New York : Wiley, 1995.

Engel, Robert E. and Clive W.J.Granger. "Cointegration and Error – Correction Representation, and Testing." **Econometric** 55(March 1987),251-276.

Hataiseree, R. "Vector Autogression, Unit Roots, Cointegration and Error - Correction" Mechanism : A General Overview." **Chulalongkorn Journal of Economics**, 8(May 1996) : 263-294

Johansen, Soren and Katerina Juselius "Maximum Likelihood Estimation and Inference on Cointegration with Application to the Demand for Money." Oxford Bullrtin of **Economics and statistics**, 52(1990), 196-209.

Johnston, J. and DiNardo, J. **Econometric Methods**. Singapore : McGraw – Hill, 1997.

Pindyck, Robert S. and Rubinfeld, Deniel L. **Econometric Models and Economic Forecasts**. Singapore : McGraw – Hill, 1998.